

ABSTRAK

Neural Network merupakan suatu jaringan yang menyerupai jaringan otak manusia, yang dapat menyimpulkan suatu hasil berdasarkan fakta-fakta atau pengalaman yang pernah dialaminya. Banyak aplikasi dalam kehidupan sehari-hari yang telah menerapkan *Neural Network* ini. Dalam tesis ini, dibandingkan hasil peramalan saham ANTM (PT Aneka Tambang) dengan metode *Artificial Neural Network* dan ARIMA. ARIMA merupakan teknik peramalan berdasarkan *time-series*, yaitu peramalan berdasarkan pola yang ada. Dan dari hasil dari penelitian menunjukkan bahwa hasil peramalan dengan menggunakan metode *Artificial Neural Network* mempunyai nilai akurasi yang lebih tinggi dari hasil peramalan dengan metode ARIMA.

Kata Kunci: *Artificial Neural Network, ARIMA, time-series, peramalan saham, ANTM, Aneka Tambang*

ABSTRACT

Neural Network is a network that resembles a human brain tissue, which may infer a result based on the facts or experience that happened. Many applications have implemented neural network. In this thesis, we compared the stock forecasting result of ANTM (PT Aneka Tambang) using Artificial Neural Network and ARIMA. ARIMA is a technique of time-series forecasting, which means forecast based on the existing pattern. The results of the study showed that forecasting using Artificial Neural Network method has higher accuracy value than the results with ARIMA method.

Keyword: *Artificial Neural Network, ARIMA, time-series, stock forecasting, ANTM, Aneka Tambang*